工银瑞信核心价值股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银核心价值股票
交易代码	481001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年8月31日
报告期末基金份额总额	17,566,173,269.80份
投资目标	有效控制投资组合风险,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	股票价格终将反映其价值。本基金投资于经营稳健、具有核心竞争优势、价值被低估的大中型上市公司,实现基金资产长期稳定增值的目标。
业绩比较基准	75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普金债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的大中盘价值型基金,一般情况下,其风险及预期收益高于货币市场基金、债券基金及混合型基金
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	269,567,801.39
2.本期利润	697,296,229.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0362
4.期末基金资产净值	6,402,290,925.10
5.期末基金份额净值	0.3645

注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

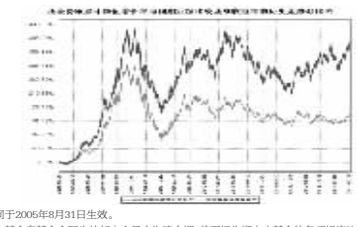
(3)所列数据截止到2014年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	11.26%	0.95%	10.17%	0.66%	1.09%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金基金合同于2005年8月31日生效。

2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同关于资范围、投资禁止行为与限制的规定:本基金股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%,债券及现金资产占基金资产净值的比例为5%-40%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何江旭	权益投资总监,曾任本基金的基金经理。	2010年4月12日	2014年7月30日	17	曾担任国泰基金金鑫、基金金鼎、金马稳健回报、金鹰增长以及金牛创新成长基金的基金经理,基金管理部总监兼权益投资副总监;2009年加入工银瑞信,现任权益投资总监,兼任工银瑞信投资管理有限公司联席总经理;2010年4月12日至2014年7月30日,担任工银核心价值基金基金经理;2011年4月21日至2014年7月30日,担任工银消费服务行业基金的基金经理。
宋炳坤	研究部总监,本基金的基金经理	2014年1月20日	-	10	曾任中信建投证券有限公司研究员; 2007年加入工银瑞信,现任研究部总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2013年1月28日至今,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银红利基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银核心价值基金基金经理。
何肖颜	权益投资部副总监,本基金的基金经理	2014年3月6日	-	16	曾任博时基金基金裕阳的基金经理助理,基金裕华的基金经理,博时新兴成长股票型基金的基金经理;2004年5月至2005年1月担任社保基金管理小组基金经理助理;2008年加入工银瑞信,现任权益投资部副总监,2014年3月6日至今,担任工银瑞信核心价值基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,宏观经济短期企稳,加上改革预期提升,股票市场出现今年以来较为可观的上涨,沪深300指数上涨13.20%,其中中小盘股票的主题投资机会相对大盘股的估值回升表现更佳。我们认为市场虽有反弹但不大可能短期就迎来趋势性的整体性机会,原因主要有如下两点:一是目前来看,中国经济在房地产投资下行的影响下仍然比较疲弱,各种工业品的价格均处于下行趋势中,企业盈利改善的空间并不大;二是对于估值来说,虽然经济转型、改革红利短期内对市场风险偏好的提升较为明显,但是目前高企的全社会杠杆水平大大抑制了无风险收益率以及社会融资成本的改善。因此无论是从盈利还是估值的角度来看,短期内出现趋势性行情的基础还不够牢固。

报告期本基金主要是降低了信息技术、可选消费行业的配置,增加了公用事业、医疗保健、材料、日常消费等方面的配置。本基金的组合结构相对更加均衡化,相对基准的偏离度逐步降低,目前相对基准超配的行业有信息技术、医疗保健、公用事业,其余行业均有不同程度的低配。

报告期本基金的业绩增长率低于业绩基准表现,从业绩归因来看,主要是可选消费和信息技术两个行业的个别重仓个股短期内贡献了比较突出的负超额收益。对此我们从个股的基本面和具体配置做了相应的研究和调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为11.26%,业绩比较基准收益率为10.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,长期来看,股票市场趋势性行情的形成需要来自盈利和估值两方面的共同推动。虽然我们并不认为牛市会在短期内来临,但是可以看到无论是政策还是市场都正在逐步向着这一方向发展:改革不断深化所释放的红利大大提升了企业的经营效率,房地产需求趋势性回落降低资金的需求,有助于社会融资成本的改善,这些也是我们长期看好股市的基础。基于上述对经济和改革趋势的分析,我们相对看好信息技术、医疗保健、公用事业等行业在技术进步和制度改革创新的双重刺激下的投资机会,但是这些投资机会将更多的来自于自下而上的个股选择,我们将更加专注于此以提高业绩回报投资者。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,646,124,790.51	84.63
	其中:股票	5,646,124,790.51	84.63
2	固定收益投资	386,803,269.50	5.80
	其中:债券	386,803,269.50	5.80
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	90,300,000.00	1.35
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	30,292,797.58	0.45
7	其他资产	518,193,985.02	7.77
8	合计	6,671,714,842.61	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,638,764.96	0.10
B	采矿业	143,587,508.10	2.24
C	制造业	2,979,771,564.54	46.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	474,886,611.66	7.42
E	建筑业	159,657,686.72	2.49
F	批发和零售业	26,559,488.72	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,610,115.20	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	510,973,288.30	7.98
J	金融业	648,967,024.09	10.14
K	房地产业	423,471,056.12	6.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	267,001,682.10	4.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,646,124,790.51	88.19

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002049	同方国芯	8,512,553	287,894,542.46	4.50
2	600835	上海机电	15,000,084	283,201,585.92	4.42
3	300144	宋城演艺	10,000,063	267,001,682.10	4.17
4	000712	锦龙股份	15,000,039	265,350,689.91	4.14
5	002439	启明星辰	10,585,376	256,166,099.20	4.00
6	600776	东方通信	23,539,664	243,635,522.40	3.81
7	000002	万 科A	26,169,396	240,235,055.28	3.75
8	600276	恒瑞医药	4,302,694	159,500,866.58	2.49
9	000883	湖北能源	31,999,388	147,517,178.68	2.30
10	600979	广安爱众	20,350,981	145,713,023.96	2.28

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	379,620,000.00	5.93
	其中:政策性金融债	379,620,000.00	5.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	7,183,269.50	0.11
6	中期票据	-	-
8	其他	-	-
9	合计	386,803,269.50	6.04

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14国开13	3,400,000	339,524,000.00	5.30
2	140204	14国开04	400,000	40,096,000.00	0.63
3	110025	国金转债	58,150	7,183,269.50	0.11

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,407,325.92
2	应收证券清算款	508,579,660.54
3	应收股利	-
4	应收利息	5,762,299.56
5	应收申购款	1,444,699.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	518,193,985.02

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	20,109,649,702.42
报告期期间基金总申购份额	461,311,484.28
减:报告期期间基金总赎回份额	3,004,787,916.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	17,566,173,269.80

注:1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准工银瑞信核心价值股票型证券投资基金设立的文件;

2、《工银瑞信核心价值股票型证券投资基金基金合同》;

3、《工银瑞信核心价值股票型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件和营业执照;

5、基金托管人业务资格批件和营业执照;

6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信红利股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	工银红利股票
交易代码	481006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年7月18日
报告期末基金份额总额	2,013,233,974.04份
投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略,通过红利股筛选、竞争优势评价和盈利预测的选股流程,精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象,以增强本基金的股息收益和资本增值能力。
业绩比较基准	中证红利指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的红利主题型基金,其风险与预期收益高于债券型基金以及混合型基金
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

注:本基金业绩比较基准自2014年9月10日由"届时中国A股红利150指数收益率"变更为"中证红利指数收益率"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	52,101,150.36
2.本期利润	267,167,563.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.1290
4.期末基金资产净值	1,613,765,308.72
5.期末基金份额净值	0.8016

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、所列数据截止到2014年9月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.36%	0.87%	18.71%	0.89%	0.65%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金合同于2007年7月18日生效。

2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期。截至报告期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同关于投资范围及投资限制的规定:本基金投资股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-95%,现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-40%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋炳坤	研究部总监,本基金的基金经理	2014年1月20日	-	10	曾任中信建投证券有限公司研究员; 2007年加入工银瑞信,现任研究部总监。2012年2月14日至今,担任工银瑞信添颐债券型证券投资基金基金经理;2013年1月18日至今,担任工银双利债券基金基金经理;2013年1月28日至今,担任工银瑞信60天理财债券型基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银红利基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银核心价值基金基金经理。
杨柯	研究部副总监,本基金的基金经理	2014年1月20日	-	6	曾任中国国际金融有限公司研究员;2011年加入工银瑞信,现任研究部副总监。2013年4月16日至今,担任工银瑞信稳健成长股票基金基金经理;2014年1月20日至今,担任工银红利基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

工银红利的投资策略继续是:自上而下盯PMI、发电量、政策、货币流动性;自下而上根据自己编制的财务模型来挑选个股。相比2009-2013年,A股的仓位和行业选择,与PMI和行业盈利增速绝对值高度正相关;2014年的股市行情,主要是炒的转型改革能成功的预期。再加上,去年年底和今年年初新上了一大批1980年左右出生的基金经理,好奇心更重。所以,就促使今年股市行情出现,传统行业与新兴行业拥有各自的粉丝,新兴行业投资者占主导并呈现出牛市的状态。三季度,工银红利主要是投资转型改革行业的个股,并且,四季度也会延续该策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为19.36%,业绩比较基准收益率为18.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中国经济转型改革之际,要么相信转型成功,死多A股;要么相信转型不成功,移民或将资产全部转成黄金。行业选择上,继续偏多转型改革行业,除非流动性收缩或改革受阻。由于炒的是转型改革能成功的预期,所以,投资风格采取类似VC/PE的方法:重视新兴和政策扶持性行业,挑选管理层;寻找中小市值公司,淡化短期估值;不断试错,不断调研和发现新标的,这会导致涨多了会调整,新标的替换不靠谱的老标的。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,403,922,066.30	86.56
	其中:股票	1,403,922,066.30	86.56
2	固定收益投资	79,888,000.00	4.93
	其中:债券	79,888,000.00	4.93
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	46,722,914.24	2.88
7	其他资产	91,384,892.94	5.63
8	合计	1,621,917,873.48	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,034,674.60	0.06
B	采矿业	40,762,195.43	2.53
C	制造业	753,069,706.26	46.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,029,079.13	4.90
E	建筑业	17,598,374.44	1.09
F	批发和零售业	8,451,498.60	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	27,573,429.42	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	220,257,524.04	13.65
J	金融业	204,125,174.82	12.65
K	房地产业	32,306,323.08	2.00
L	租赁和商务服务业	1,473,628.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	17,138,903.04	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,101,555.44	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,403,922,066.30	87.00

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300281	金明精机	3,300,126	84,153,213.00	5.21
2	002421	达实智能	2,438,097	77,287,674.90	4.79
3	300006	莱美药业	2,200,079	75,462,709.70	4.68
4	300049	福瑞股份	1,844,879	67,522,571.40	4.18
5	300213	佳讯飞鸿	2,300,000	52,417,000.00	3.25
6	000712	锦龙股份	2,696,742	47,705,365.98	2.96
7	000403	*ST生化	1,549,994	35,727,361.70	2.21
8	300377	赢时胜	499,854	34,949,791.68	2.17
9	600406	国电南瑞	2,030,957	34,790,293.41	2.16
10	601166	兴业银行	3,346,900	34,205,318.00	2.12

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	79,888,000.00	4.95
	其中:政策性金融债	79,888,000.00	4.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	79,888,000.00	4.95

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14国开13	800,000	79,888,000.00	4.95

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内,本基金未运用股指期货进行投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明:

根据振兴生化2013年10月16日公告,公司存在下列违规行为:

1. 关联担保未履行审议程序和披露义务

2006年6月29日,振兴电业与中国银行运城分行签订了2006年振兴抵字03号《最高额抵押合同》,并在向津市工商行政管理局就振兴电业5.34亿元的固定资产办理了抵押登记(河工商河押字第06014号《抵押物登记证》)。上述为关联人签订担保合同以及主要资产被办理抵押登记的情况,振兴生化未履行审议程序,也未及时披露,直到2013年5月6日在本所的监管要求下,才发布《关于对外担保情况的自查公告》。

2. 重大诉讼未履行披露义务

2012年5月,因山西振兴集团未能偿还借款本金及利息,债权人向法院起诉山西振兴集团以及四位担保人振兴电业、振兴集团、史跃武和山西振兴集团铝业公司,诉讼金额约6.86亿元,涉及振兴电业的诉讼请求是,在担保范围内承担担保责任,并对2006年振兴抵字03号《最高额抵押合同》项下的抵押物优先受偿。上述诉讼事件发生后,振兴生化未及时履行披露义务,直到2013年4月24日才发布重大诉讼提示性公告。对此,振兴生化对外公告称是因振兴集团未及时向其转交相关诉讼材料,导致其未能及时履行披露义务。

3. 对外财务资助未履行审议程序和披露义务

自2009年3月,振兴生化子公司广东双林生物制药有限公司(以下简称"广东双林")开始与山西离石市企业家李志强合作共同投资设立单采血浆有限公司(站)。截至2012年底,双方共设立了5家单采血浆有限公司(站)。在此过程中,广东双林为李志强提供借款以及其他财务资助形式共约0.24亿元。对上述财务资助行为,振兴生化未履行董事会审议程序和披露义务。

4. 未按规定做好投资者关系管理工作

2013年以来,投资者多次投诉振兴生化不接咨询电话,也不及时回答投资者在本所"互动易"平台上的咨询问题。

5. 拒不配合深圳交易所监管工作。

2013年6月3日,深圳交易所向振兴生化发出年报问询函((2013)第384号),明确要求振兴生化于6月5日前回复。其后,尽管本所相关人员多次催促,但振兴生化直到6月28日才提交回复,且未严格按照问询函要求回复相关问题,也未提交会计师专项说明、相关合同、单据等书面材料。7月10日,本所向其发出监管函(公司部监管函(2013)第59号),要求振兴生化于7月12日前严格按照本所问询函要求予以回复。尽管振兴生化再次提交回复,但因会计师与保荐机构就公司与振兴集团之间资金往来的相关意见相矛盾,振兴生化拖延提供回复函件以及会计师专项说明的盖章页,截至目前仍未提交相关文件的盖章页。

振兴生化的上述行为,违反了本所《股票上市规则(2008年修订)》第1.4条、第2.18条、第9.11条、第11.11.2条规定、本所《股票上市规则(2012修订)》第1.4条、第2.18条、第6.14条、第9.11条、第11.11.2条规定以及本所《主板上市公司规范运作指引》第8.12条的规定。

鉴于上述违规事实及情节,依据深圳证券交易所《股票上市规则(2012年修订)》第17.2条、第17.3条、第17.4条、第19.3条的相关规定,经深圳证券交易所纪律处分委员会审议通过,本所对振兴生化给予公开谴责的处分。

上述所列事项对公司的生产经营活动基本无影响。

报告期内本基金投资的其他前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	561,699.90
2	应收证券清算款	89,509,288.86
3	应收股利	-
4	应收利息	1,034,223.88
5	应收申购款	279,680.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,384,892.94

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,224,263,315.16
报告期期间基金总申购份额	18,171,088.09
减:报告期期间基金总赎回份额	229,200,429.21
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,013,233,974.04

注:1.报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2.报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准工银瑞信红利股票型证券投资基金设立的文件;

2.《工银瑞信红利股票型证券投资基金基金合同》;

3.《工银瑞信红利股